

# 中银理财-稳富（周周开）0201 2023 年年度投资运作情况报告

理财产品管理人：中银理财有限责任公司

理财产品托管人：中国银行股份有限公司

报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

### 一、理财产品基本情况

理财产品代码	WFZZK0201
理财产品名称	中银理财-稳富（周周开）0201
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000265
产品类型	固定收益类产品
募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型产品
产品币种	人民币
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2021-04-28
理财产品到期日	无固定期限

### 二、存续规模、收益表现及杠杆水平

(一) 截至报告期末，理财产品存续规模及收益表现如下：

理财产品 份额代码	理财产品 总份额	理财产品 份额净值	理财产品 份额累计净值	理财产品 资产净值	较上一报告期 份额净值 增长率
WFZZK0201	2,271,622,502.13	1.079209	1.079209	2,451,556,211.25	2.84%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：106.09%

### 三、理财产品持仓情况

资产类别	穿透前金额 (万元)	占全部产品总资 产的比例	穿透后金额 (万元)	占全部产品总资 产的比例
现金及银行存款	13,033.80	5.32%	164,387.58	64.44%
同业存单	-	0.00%	27,464.55	10.77%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	6,840.77	2.68%
债券	16,044.25	6.54%	53,513.26	20.98%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	-	0.00%
境外投资资产	-	0.00%	-	0.00%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	-	0.00%	2,893.65	1.13%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	216,119.46	88.14%	-	0.00%
合计	245,197.51	100%	255,099.82	100%

#### 四、产品持仓前十项资产

序号	资产名称	持仓（万元）	持仓比例
1	Depo_nh_20230921_AX55: 存放同业	37,928.69	14.87%
2	100201030110023052501: 存放同业	22,046.52	8.64%
3	CNY: 现金及银行存款	15,187.08	5.95%
4	110023060201: 存放同业	11,023.26	4.32%
5	Depo_jh_20230915_AX55: 存放同业	9,482.16	3.72%
6	Depo_jh_20230613_CZ: 存放同业	6,725.21	2.64%
7	DQ033386: 存放同业	5,988.07	2.35%
8	DQ000453: 存放同业	5,613.81	2.20%
9	Depo_jh_20230707_XT: 存放同业	5,043.91	1.98%
10	240302: 23 安信 S4	5,007.13	1.96%

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

## 五、投资账户信息

户名	中银理财有限责任公司（稳富周周开 0201）
账号	757574782283
开户行	中国银行深圳市分行营业部

## 六、产品组合流动性风险分析

本产品为面向机构客户的产品，通过保持较高比例现金，以及缩短资产久期，整体流动性风险可控，全年未发生流动性风险。

## 七、本运作期主要操作回顾

### （一）主要投资策略及操作

主要投资于低波动资产，全年净值稳定上升，回撤较小，并保持较高收益率。同时，保持较高比例现金资产，以应对流动性风险。

### （二）非标资产投资情况

无

### （三）关联交易情况

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期间投资于关联方发行的证券

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
-	-	-	-	-

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期间投资于关联方承销的证券

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券
-------	------	------	----------

			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	920	92,000.00
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资产)	41,820	4,182,000.00
中国银行股份有限公司	012384592	23 苏国信 SCP020	60,232	6,023,189.50
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	47,530	4,753,000.00
中国银行股份有限公司	102381009	23 锡产业 MTN005	14,180	1,418,000.00
中国银行股份有限公司	102381010	23 锡产业 MTN004	14,180	1,418,000.00
中国银行股份有限公司	102381660	23 南山开发 MTN002	147,990	14,799,000.00
中国银行股份有限公司	102381732	23 国新租赁 MTN001	197,320	19,732,000.00
中国银行股份有限公司	102381966	23 华宝都鼎 MTN001	30,820	3,084,606.35
中国银行股份有限公司	102381966	23 华宝都鼎 MTN001	30,820	3,082,000.00
中国银行股份有限公司	132380062	23 融和融资 GN005(乡村振兴)	30,820	3,082,000.00
中国银行股份有限公司	180322	18 进出 22	1,840	190,505.56
中国银行股份有限公司	180322	18 进出 22	11,040	1,142,517.70
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二级 01	1,256	126,881.42
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二级 01	3,767	380,669.89
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二级 01	52,014	5,291,693.61
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	121,366	12,322,860.68
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	17,338	1,761,272.08
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	17,338	1,752,746.60
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	3,139	317,430.50

中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	3,139	316,922.63
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	34,676	3,521,529.86
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	628	63,482.08
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	1,256	127,144.72
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	1,256	127,204.48
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	1,287	130,199.59
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	2,574	260,410.24
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	3,139	317,836.99
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	3,217	325,456.82
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	643	65,092.65
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	1,256	127,159.28
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	1,883	190,617.63
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	2,511	254,247.00
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	2,511	254,247.00
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	628	63,582.09
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	628	63,553.52
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	1,256	127,219.30
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	1,883	190,747.96
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	3,139	317,944.66
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	3,767	381,468.05
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	3,767	381,468.05
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	5,022	508,877.19

中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	628	63,595.08
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	4,394	444,460.71
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	5,022	507,969.16
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	1,256	126,772.82
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	1,287	129,873.89
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	1,883	189,990.48
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	3,217	324,703.69
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	643	64,982.88
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	190,120	19,389,306.68
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	27,600	2,911,545.85
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	6,440	679,130.31
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	95,060	9,694,653.34
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	223,861	22,939,450.87

中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	1928018	19 工商银行永 续债	482,971	49,440,225.66
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	1928018	19 工商银行永 续债	656	66,222.38
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	1928018	19 工商银行永 续债	7,533	760,669.30
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	1,256	126,620.39
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	1,256	126,604.70
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	1,883	190,024.94
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	1,883	189,895.37
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	2,511	253,209.39

中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	2,574	259,762.18
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	3,861	389,466.46
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	3,861	389,666.82
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	628	63,285.65
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028006	20 邮储银行永 续债	655	66,017.40
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028017	20 农业银行永 续债 01	1,930	194,442.92
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028017	20 农业银行永 续债 01	643	64,775.32
中银国际证 券股份有限 公司	1828013	18 建设银行二 级 02	3,680	380,668.05
中银国际证 券股份有限 公司	1828013	18 建设银行二 级 02	4,600	475,934.32
中银国际证 券股份有限 公司	1828013	18 建设银行二 级 02	6,440	666,137.54

中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	3,680	375,040.21
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	52,020	5,348,490.20
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	6,440	656,845.75
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	4,600	468,873.16
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	52,020	5,347,817.76
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	86,700	8,914,221.07
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	52,020	5,343,727.81
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	34,680	3,562,321.67
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	4,600	468,721.12
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	9,200	936,677.96
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	22,080	2,352,830.86
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	1,883	190,216.10
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	17,338	1,764,977.89
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	2,511	253,592.59

中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	2,511	253,083.34
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	34,676	3,529,802.11
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	4,600	481,486.66
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	86,690	8,825,050.94
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	103,678	10,580,004.31
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	120,197	12,253,065.29
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	132,054	13,498,616.97
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	150,021	15,308,009.10
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	176,072	17,998,155.96
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	2,511	253,823.62
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	44,018	4,499,538.99
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	48,297	4,933,107.09
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	628	63,456.53
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	88,036	8,999,077.98

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	95,060	9,672,090.79
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	237,650	24,108,005.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	241,486	24,590,700.41
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	47,530	4,821,601.02
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	47,530	4,821,601.02
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	48,297	4,918,140.08
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	628	63,375.80
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	89,545	9,128,133.19
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	9,417	951,121.01
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	95,060	9,643,202.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	1,256	126,843.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	1,883	190,208.95
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	3,139	317,167.15
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	6,278	634,023.55

中银国际证 券股份有限 公司	UL497937	中合 1A	1,940	194,000.00
----------------------	----------	-------	-------	------------

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期间投资于关联方发行的资产管理产  
品

关联方名称	资产管理 产品代码	资产管理产品 简称	报告期内买入资产管理产品	
			数量（单位：份）	总金额（单位：元）
中银国际证 券股份有限 公司	DXZYLCZ YZQ20211 6	中银证券-中 银理财 16 号 单一资产管理 计划	10,481,182	11,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	DXZYLCZ YZQ20211 6	中银证券-中 银理财 16 号 单一资产管理 计划	10,483,179	11,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	DXZYLCZ YZQ20211 6	中银证券-中 银理财 16 号 单一资产管理 计划	43,161,327	45,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	DXZYLCZ YZQ20211 6	中银证券-中 银理财 16 号 单一资产管理 计划	86,140,888	90,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	DXZYLCZ YZQ20211 6	中银证券-中 银理财 16 号 单一资产管理 计划	9,534,706	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	DXZYLCZ YZQ20211 6	中银证券-中 银理财 16 号 单一资产管理 计划	90,003,830	94,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D10	中银基金-财 稳 10 号 QDII 集合资产管理 计划	50,000,000	50,000,000.00

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期间的其他关联交易

交易类型	关联方名称	总金额（单位：元）
------	-------	-----------

销售服务费	中国银行股份有限公司	4,429,980.79
产品托管费	中国银行股份有限公司	590,664.10
1日质押式正回购	中银基金管理有限公司	4,056,905.60
1日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	20,846,000.00
1日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	2,550,000.00
3日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	1,870,000.00
6日质押式正回购	中银基金管理有限公司	2,760,000.00
现券买入	中国银行股份有限公司	137,199,000.00
现券买入	中银国际证券股份有限公司	100,124,565.25
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	275,774,219.36
证券交易佣金	中银国际证券股份有限公司	8,454.73

## 八、后市展望及下阶段投资策略

预计今年稳增长政策力度加大，货币政策保持稳健宽松，市场流动性保持合理充裕状态，债券市场收益率呈现低位震荡。本产品将继续坚持低波资产投资策略，持续加强精细化管理，力争净值稳定上升。

中银理财-稳富（周周开）0201

2023 年年度托管人报告

中银理财有限责任公司：

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中银理财-稳富（周周开）0201（以下称“本理财产品”）的托管过程中，严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《商业银行理财业务监督管理办法》和托管合同等文本的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害理财产品份额持有人利益的行为。

根据《商业银行理财业务监督管理办法》，本托管人对报告期内本理财产品的 2023 年年度投资运作情况报告进行了复核，复核意见如下：

经复核，净值数据核对无误。

报告期内，本托管人依据理财相关法律法规规定及托管合同对本理财产品的投资运作进行必要监督，报告期内尽职履行理财产品发行人通知及监管报告义务。

中国银行股份有限公司深圳市分行托管业务部

2024 年 02 月 26 日

